



首页
概况
研究机构
学者介绍
成果文库
文献数据
培训教育
对外交流

□ 您的位置: 首页 → 数技经济研究杂志 → 现实经济问题研究

对单位根检验PT统计量响应面函数的研究

【摘要】 Elliott等人于1996年提出了针对特定备择假设具有最优特性的PT单位根检验统计量。这一检验方法逐渐引起了众多计量经济学家的重视,并且被收入了一些新版本的计量软件包。但在实际运用时由于现有的临界值是在原文献给出的四个样本容量相应临界值的基础上插值而得,因而准确性较低,使得检验结果的可靠性受到了影响。本文利用Monte Carlo模拟的方法给出了在相当广泛的样本容量范围内临界值的近似计算公式,并对响应面函数法与插值法的结果做了一个简单的比较。

关键词: 单位根检验 PT统计量 Monte Carlo模拟 响应面函数

Search the Web

Find It

地址: 北京市建国门内大街5号 邮政编码: 100732 电话及传真: 010-65125895、010-65137561
版权所有 (c) 中国社会科学院数量经济与技术经济研究所
联系我们 E-mail to: iqte@cass.org.cn